

GMM GLOBAL OPPORTUNITIES BALANCED FUND

ΠΙΝΑΚΑΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ 2016

Τρίμηνο: Γ

ΣΥΝΘΕΣΗ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ ΑΜΟΙΒΑΙΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΟΥ	ΤΕΜΑΧΙΑ	ΤΙΜΗ	ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΑΞΙΑ
		ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑΣ ΗΜΕΡΑΣ ΤΡΙΜΗΝΟΥ
I. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΔΙΑΘΕΣΙΜΑ ΚΑΤΑΘΕΣΕΙΣ			
CASH ACCOUNT IN AUD	202,2500	0,68226786	137,99
CASH ACCOUNT IN DKK	2.277,6000	0,13420477	305,66
CASH ACCOUNT IN HKD	7.282,9600	0,11554416	841,50
NATIONAL BANK OF GREECE (CYPRUS) CASH IN EURO			164.935,00
CASH ACCOUNT IN NOK	20.159,4600	0,11127803	2.243,30
CASH ACCOUNT IN USD	131.972,8500	0,89597706	118.244,65
EUROBANK CYPRUS CASH IN EURO			77.279,94
CASH ACCOUNT IN GBP	789,4700	1,16139972	916,89
ΣΥΝΟΛΟ I.1			364.904,93
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
CYPRUS 06/5/2022	500,0000	104,31350000	52.156,75
- Isin: XS1227247191			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-15 - 06-MAY-22 Επιτόκιο: 3.875%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B-			
- Πρόσθετοι Όροι:			
CYPRUS 3.75 26/7/2023	300,0000	103,16950000	30.950,85
- Isin: XS1457553367			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 26-JUL-16 - 26-JUL-23 Επιτόκιο: 3.75%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
REP OF CYPRUS 4/11/2025	1.000,0000	106,45650000	106.456,50
- Isin: XS1314321941			
- Εκδότης: REPUBLIC OF CYPRUS			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 04-NOV-15 - 04-NOV-25 Επιτόκιο: 4.25%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B+			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			189.564,10
ΣΥΝΟΛΟ I.2			189.564,10
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟΥ (I)			
554.469,03			
II. ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ			
1. ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ- ΕΓΕΔ			
FIXED			
Q & R UK LTD 21/7/2017 6	700,0000	100,00000000	70.000,00
- Isin: CY0144830912			
- Εκδότης: QUALITY & RELIABILITY			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 22-JUL-14 - 21-JUL-17 Επιτόκιο: 6%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: NA			
- Πρόσθετοι Όροι:			
PPC FINANCE 1/5/2019	1.000,0000	82,19800000	82.198,00
- Isin: XS1063837741			
- Εκδότης: PUBLIC POWER CORP FIN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 08-MAY-14 - 01-MAY-19 Επιτόκιο: 5.5%			
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed Πηγή: BLOOMBERG			
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: CCC-			
- Πρόσθετοι Όροι:			

INTRALOT CAPITAL LUX, 15/9/2021	1.000,0000	100,12900000	100.129,00
- Isin: XS1405774727			
- Εκδότης: INTRALOT CAPITAL LUX			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 15-SEP-16 - 15-SEP-21	Επιτόκιο: 6.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: B1			
- Πρόσθετοι Όροι:			
EUROPEAN INVT 1.5%, 12/05/2022	4.500,0000	11,28092138	50.764,15
- Isin: XS1227593933			
- Εκδότης: EUROPEAN INVESTMENT BANK			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 12-MAY-15 - 12-MAY-22	Επιτόκιο: 1.5%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
NORWEGIAN GOV 24/5/2023	4.250,0000	11,82685139	50.264,12
- Isin: NO0010646813			
- Εκδότης: NORWEGIAN KINGOM			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 24-MAY-12 - 24-MAY-23	Επιτόκιο: 2%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
AUSTRALIAN GOVERNMENT 21/4/2024	500,0000	72,40226513	36.201,13
- Isin: AU3TB0000143			
- Εκδότης: AUSTRALIAN GOVERNMENT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 21-APR-12 - 21-APR-24	Επιτόκιο: 2.75%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Aaa			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			389.556,40
OTHER			
OESTERREICH VOLKSBANKEN 10% PERP.	200,0000	4,02500000	805,00
- Isin: XS0359924643			
- Εκδότης: OESTERREICH VOLKSBANKEN			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 06-MAY-08 - 18-JUN-18	Επιτόκιο: 10%		
- Τύπος Επιτοκίου: Other	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: Cu			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ OTHER			805,00
ΣΥΝΟΛΟ II.1			390.361,40
2. ΟΜΟΛΟΓΑ ΜΗ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΑ			
FIXED			
GLOBO TECH 9% 20/6/2018	526,2500	58,06998595	30.559,33
- Isin: GB00BBHXPS12			
- Εκδότης: GLOBO TECHNOLOGIES UK LT			
- Ην/νια Έναρξης - Λήξης: 20-JUN-13 - 20-JUN-18	Επιτόκιο: 9%		
- Τύπος Επιτοκίου: Fixed	Πηγή: BLOOMBERG		
- Πιστοληπτική Διαβάθμιση: N/A			
- Πρόσθετοι Όροι:			
ΣΥΝΟΛΟ FIXED			30.559,33
ΣΥΝΟΛΟ II.2			30.559,33
3. ΜΕΤΟΧΕΣ ΕΙΣΗΓΜΕΝΕΣ			
PRADA	10.400,0000	2,86549505	29.801,15
QUALITY & RELIABILITY SA	50.000,0000	0,38500000	19.250,00
ΣΥΝΟΛΟ II.3			49.051,15
4. MARGIN			
MARGIN BETA SEC IN EURO / EUREX			26.369,55
MARGIN IN USD/BETA	8.275,8800	0,89597706	7.415,00
ΣΥΝΟΛΟ II.4			33.784,55

5. ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΟΣΕΚΑ

ISHARES EM ASIA MLCL GOV BND	580,0000	85,84000000	49.787,20
DBX II ITRX CROSSOVER SHORT	620,0000	49,22000000	30.516,40
ΣΥΝΟΛΟ II.5			80.303,60
ΣΥΝΟΛΑ ΕΠΕΝΔΥΣΕΙΣ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (II)			584.060,03

ΣΥΝΟΛΑ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II)

1.138.529,06

ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ / ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

1.326,21

ΣΥΝΟΛΟ ΚΑΘΑΡΟΥ ΕΝΕΡΓΗΤΙΚΟΥ (I) + (II) + ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ - ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ

1.139.855,27

IV. ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ

1. FUTURES ON STOCKS

E-MINI SILVER FUT DEC16	2,0000	19,21250000	86.069,80
- Χρηματιστήριο: CME CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Χώρα: UNITED STATES			
DAX MINI FUTURE DEC16	2,0000	10.512,50000000	105.125,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY			

ΣΥΝΟΛΟ IV.1

191.194,80

2. OPTIONS ON STOCKS

OPTION DAX 12/16/16	10,0000	13,90000000	695,00
- Χρηματιστήριο: FRANKFURT Χώρα: GERMANY			

ΣΥΝΟΛΟ IV.2

695,00

ΣΥΝΟΛΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ ΕΞΩΤΕΡΙΚΟΥ (IV)

191.889,80

ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ (III) + (IV)

191.889,80

GMM GLOBAL MONEY MANAGERS LTD
Στασίνου 36, 2003 Λευκωσία, Κύπρος